

国联安双佳信用分级债券型证券投资基金

2012] 第四季度报告

基金管理人:国联安基金管理有限公司

基金托管人:中国光大银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一三年一月十九日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员和基金经理等人员声明:本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国光大银行股份有限公司对本基金合同规定,于2013年1月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告、基金份额持有人名册等数据,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告自2012年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 国联安双佳信用分级债券(场内简称:国联双佳)

基金主代码 162511

基金运作方式 契约型

基金合同生效日 2012年6月4日

报告期末基金份额总额 1,079,290,544.24份

投资目标 在严格控制风险的前提下,通过积极主动地投资管理,力争获取高于业绩比较基准的稳定的投资收益。

投资策略 本基金主要采取利率策略、信用策略、息差策略,转债投资策略等策略进行投资,信用风险以及流动性风险的基础上,主动寻找价值低估的固定收益投资品种,构建及动态调整固定收益投资组合,以期获得最大化的债券收益;并通过适当参与二级市场权益类品种投资,力争获取超额收益。

业绩比较基准 中债综合指数

本基金为信用型基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其预期风险与收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

基金管理人 国联安基金管理有限公司

基金托管人 中国光大银行股份有限公司

下属两级基金的基金简称 国联安双佳(A)信用分级债券(场内简称:双佳A);国联安双佳(B)信用分级债券(场内简称:双佳B)

下属两级基金的交易代码 162512 150080

报告期末下属两级基金的份额总额 587,315,591.37份 491,974,952.87份

下属两级基金的风险收益特征 预期低风险、预期收益相对预期较高风险、预期较高收益率

注:本基金合同生效之日起3年内,本基金的基金份额划分为国联安双佳(A)信用分级债券(以下简称“双佳A”);国联安双佳(B)信用分级债券(以下简称“双佳B”),其中双佳A、基金合同生效后3年内转换为上市开放式基金(LOF)。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年10月1日-2012年12月31日)

1.本期已实现收益 14,228,401.90

2.本期利润 31,592,619.26

3.加权平均基金份额本期利润 0.0216

4.期末基金资产净值 1,072,960,905.09

5.期末基金份额净值 0.994

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,包含停牌股票按公允价值调整的余额;2.上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,例如:开放式基金的申购赎回费等,计入费用后实际收益将低于前述数字。

3.基金经估值方法及其说明

4.2 上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,例如:开放式基金的申购赎回费等,计入费用后实际收益将低于前述数字。

3.2 基金合同生息以来基金累计份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.1 本基金累计份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年6月4日至2012年12月31日)

3.2.2 本基金合同生息以来基金累计份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.3 本基金合同生息以来基金累计份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.4 本基金合同生息以来基金累计份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.5 本基金合同生息以来基金累计份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年6月4日至2012年12月31日)

3.2.6 本基金合同生息以来基金累计份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年6月4日至2012年12月31日)

3.2.7 本基金合同生息以来基金累计份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年6月4日至2012年12月31日)

3.2.8 本基金合同生息以来基金累计份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年6月4日至2012年12月31日)

3.2.9 本基金合同生息以来基金累计份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年6月4日至2012年12月31日)

3.2.10 本基金合同生息以来基金累计份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年6月4日至2012年12月31日)

3.2.11 本基金合同生息以来基金累计份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年6月4日至2012年12月31日)

3.2.12 本基金合同生息以来基金累计份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年6月4日至2012年12月31日)

3.2.13 本基金合同生息以来基金累计份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年6月4日至2012年12月31日)

3.2.14 本基金合同生息以来基金累计份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年6月4日至2012年12月31日)

3.2.15 本基金合同生息以来基金累计份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年6月4日至2012年12月31日)

3.2.16 本基金合同生息以来基金累计份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年6月4日至2012年12月31日)

3.2.17 本基金合同生息以来基金累计份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年6月4日至2012年12月31日)

3.2.18 本基金合同生息以来基金累计份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年6月4日至2012年12月31日)

3.2.19 本基金合同生息以来基金累计份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年6月4日至2012年12月31日)

3.2.20 本基金合同生息以来基金累计份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年6月4日至2012年12月31日)

3.2.21 本基金合同生息以来基金累计份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年6月4日至2012年12月31日)

3.2.22 本基金合同生息以来基金累计份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年6月4日至2012年12月31日)

3.2.23 本基金合同生息以来基金累计份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年6月4日至2012年12月31日)

3.2.24 本基金合同生息以来基金累计份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年6月4日至2012年12月31日)

3.2.25 本基金合同生息以来基金累计份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年6月4日至2012年12月31日)

3.2.26 本基金合同生息以来基金累计份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年6月4日至2012年12月31日)

3.2.27 本基金合同生息以来基金累计份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年6月4日至2012年12月31日)

3.2.28 本基金合同生息以来基金累计份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年6月4日至2012年12月31日)

3.2.29 本基金合同生息以来基金累计份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年6月4日至2012年12月31日)

3.2.30 本基金合同生息以来基金累计份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年6月4日至2012年12月31日)

3.2.31 本基金合同生息以来基金累计份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年6月4日至2012年12月31日)

3.2.32 本基金合同生息以来基金累计份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年6月4日至2012年12月31日)

3.2.33 本基金合同生息以来基金累计份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年6月4日至2012年12月31日)

3.2.34 本基金合同生息以来基金累计份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年6月4日至2012年12月